

Central Daily Market Report

2017年7月19日(水)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2017年7月19日		2017年7月20日		2017年7月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	800		▲ 300		▲ 2,000	
財政	0		▲ 16,600		▲ 2,000	
資金過不足	800		▲ 16,900		▲ 4,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	7,500					
国債買入	9,300		6,300			
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援					1,100	▲ 1,100
社債等買入		▲ 100				
E T F買入	400		100			
国債補充供給	▲ 500	100		500		
当預増減	17,200		▲ 10,200		▲ 4,000	
当座預金残高	3,584,500		3,574,300		3,570,300	
準備預金残高	3,188,400					
積み終了先	3,165,000					
超過準備	3,158,400					
非準備預金先	396,100					
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					2,999,300	
準備預金進捗率	実績	98.59%	日数	12.90%		

●2017年7月19日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比1兆1,000億円増加の318兆2,000億円(当座預金残高見込みは358兆5,000億円)。本日の無担O/N物は、信託・証券業態などから▲0.075~▲0.055%、地銀業態から▲0.075~▲0.05%近辺の調達希望で始まった。昨日と同様、積み期間の前半であることから、調達意欲は低調で、朝方の出会いの水準は▲0.07~▲0.045%となった。一巡後も特に取り上がる先は無く、▲0.075~▲0.06%の出会いが中心であった。ターム物は閑散な地合いだった。

<レポ市場>

GC T/N(7/20-7/21)は▲0.090~▲0.080%程度、S/N(7/21-7/24)は▲0.095~▲0.080%程度での出会い。引き続き資金調達・運用ニーズが共に厚くなく、閑散小動きの地合いとなっている。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では5Y130~132、10Y333~347、20Y155~161などにビッドの出入りが多く見られた。

<短国市場>

現先S/Nは、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.113~▲0.111%での出会いが見られる中、入札結果は平均落札利回▲0.1106%、按分落札利回▲0.1082%と堅調な結果となった。後場では、3M物が▲0.115~▲0.113%、6M物が▲0.115%、1Y物が▲0.117~▲0.114%での出会いが見られ、全般的に堅調な地合いとなった。

<CP市場>

現先レートは、引き続き低位で推移した。CP発行市場は、石油業態から大型発行が実施されたものの、発行総額は300億円程度と閑散なマーケットであった。

●短期金融市場関連指標

2017/7/19	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.084	0.070	0.005	20,020.86	20.95	111.98-00	112.14-15
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.035				-	▲ 0.093						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.097						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.115	▲ 0.111						
6M							▲ 0.109	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.151						
									日付	7/11	7/12	7/13	7/14	7/18
									日銀当預残	3,612,000	3,602,400	3,577,000	3,590,900	3,567,300
									準備預金残	3,221,600	3,220,700	3,209,300	3,193,300	3,165,000
									マネタリーベース	4,661,800	4,652,100	4,627,400	4,642,100	4,617,900
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.044%	▲0.040%	▲0.042%	▲0.055%
									コール市場残高	90,423	84,961	83,991	85,931	86,247
									うち無担	70,905	65,579	64,877	66,608	66,699
									うちO/N	45,355	39,809	39,567	42,908	43,249
									うち有担	19,518	19,382	19,114	19,323	19,548

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	697	-	43,800	2017/7/24	2017/10/23	152,738.0	35,645.5	100.0270	▲0.1082%	63.6822%	100.0276	▲0.1106%	8,154.0
流動性供給	241	-	3,000	2017/7/21		13,844.0	2,989.0		▲0.0130%	60.3951%		▲0.0160%	
交付税特会	-	-	10,500	2017/7/27	2018/1/26	147,784.0	10,500.10		0.0000%	7.1560%		0.0000%	

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	40,167	2017/7/19	2017/7/20		423	423		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,989	2017/7/19	2017/7/20		41	41		▲0.600	▲0.600	

●2017年7月20日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果発表)	*6月の貿易統計	*ECB定例理事会
*黒田日銀総裁、定例会見		
*経済・物価情勢の展望		

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入